

| <b>MADRID RESIDENCIAL I - Fondo de Titulización de Activos</b> |                      |
|--|----------------------|
| <b>LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/20 - 24/08/20</b>             |                      |
|  | <b>Euros</b>         |
| <b>I. Situación al 22/05/20:</b>                               | <b>36.013.992,66</b> |
| Fondo de Reserva   | 36.013.992,66        |
| <b>II. Fondos recibidos del emisor</b>                         | <b>6.120.807,63</b>  |
| <b>Principal:</b>  |                      |
| Según calendario hasta 31/07/20:                               | 3.897.891,21         |
| Amort. Anticipada hasta 31/07/20:                              | 1.520.065,13         |
| Ingresos por inmuebles:  | 290.927,57           |
| <b>Intereses:</b>  | <b>411.923,72</b>    |
| <b>III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):</b>            | <b>42.134.800,29</b> |
| <b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>                  | <b>-8.369,04</b>     |
| Intereses de la Cta. de Tesorería                              | -8.369,04            |
| <b>V. Recursos disponibles (III + IV):</b>                     | <b>42.126.431,25</b> |
| <b>VI. Gastos:</b>   | <b>119.685,93</b>    |
| <b>VII. Liquidación SWAP:</b>                                  | <b>113.974,42</b>    |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):                       | -226.584,39          |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (BBVA):                        | -112.609,97          |
| <b>VIII. Pago a los Bonos:</b>                                 | <b>2.681.233,17</b>  |
| <b>Bono:</b>   |                      |
| Intereses correspondientes al 24/08/20:                        | 54.206,84            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                           | 10.299,30            |
| Amortización correspondiente al 24/08/20:                      | 2.627.026,33         |
| <b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>            | <b>-10.299,30</b>    |
| <b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII ):</b>           | <b>39.439.486,57</b> |
| <b>Distribución del saldo disponible:</b>                      |                      |
| Fondo de Reserva previo (22/05/20):                            | 36.013.992,66        |
| Aportación al Fondo de Reserva                                 | -546.757,64          |
| Intereses préstamo B. pagados                                  | 131.906,72           |
| Amortización préstamo B.                                       | 2.840.550,09         |
| Remuneración Préstamo Constitución FR                          | 999.794,74           |
| Amortización Préstamo Constitución FR                          | 0,00                 |
| Intereses Crédito Subordinado                                  | 0,00                 |
| Amortización Crédito Subordinado                               | 0,00                 |
| <b>Margen de Intermediación Financiera</b>                     | <b>0,00</b>          |
| <b>Fondo de Reserva (24/08/20):</b>                            | <b>35.467.235,02</b> |

Destinatarios: CNMV, AIAF



**Nº: 3136/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL Iliq.trimAgo20

# MADRID RESIDENCIAL I

## INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 24 de Agosto de 2020

Importes en euros

| I. BONO A ES0358968008                                    | Sobre 6077 bonos | Por Bono     |
|---|------------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (30/12/08):                              | 607.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 173.038.199,56 € | 28.474,28 €  |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:  | 54.206,84 €      | 8,92 €       |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 2.627.026,33 €   | 432,29 €     |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 170.411.173,23 € | 28.041,99 €  |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 28,041990%       | 28,041990%   |

## II. EL FONDO

Importes en euros

|  |  |                  |
|--|--|------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/20: |  |                  |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:       |  | 354.582.430,91 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:          |  | 26.369.327,16 €  |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:             |  | 354.672.336,74 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:                |  | 38.450.684,97 €  |
| 2. Amortización del período 30/04/20 a 31/07/20:     |  | 5.417.956,34 €   |
| a) Según calendario:                                 |  | 3.897.891,21 €   |
| b) Amortización anticipada hasta 31/07/20:           |  | 1.520.065,13 €   |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):     |  |                  |
| b) Ultimo año:                                       |  | 2,08%            |
| c) Ultimo semestre:                                  |  | 2,00%            |
| d) Ultimo trimestre:                                 |  | 1,68%            |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:           |  | 0,63%            |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses:          |  | 0,03%            |
| 6. Porcentaje de fallidos (1):                       |  | 9,78%            |
| 7. Nivel de Impago(2):                               |  | 0,32%            |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 13 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 3137/20

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL I \Infoinver.trim\Ago20 (Español)

**MADRID RESIDENCIAL I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL PERIODO: 22/05/20-24/08/20**
**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

|   |   |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo                     | 26 de diciembre de 2008                       |
| Fecha Emisión Bonos                                 | 26 de diciembre de 2008                       |
| Fecha Final Amortización Pasivo: (2,08% TAA)        | 22 de mayo de 2034                            |
| Sociedad Gestora                                    | Titulización de Activos, SGFT,S.A.            |
| Emisores de Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Madrid)                          |
| Agente de Pagos                                     | Bankia (Caja Madrid)                          |
| Negociación Mercado                                 | Mercado AIAF                                  |
| Agencia de Calificación                             | Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación  | (M) Aa2 (sf) / (S&P) A (sf)                   |

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

| Nombre                                    | Bonos de Titulización<br>MADRID RESIDENCIAL I, FTA |
|---|--|
| Serie A:                                  |  |
| Código ISIN                               | ES0358968008                                       |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 607.700.000,00 Euros                               |
| Nominal en circulación total (actual)     | 170.411.173,23 Euros                               |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                                   |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 28.041,99 Euros                                    |
| Préstamo B:                               |  |
| Importe Inicial                           | 197.300.000,00 Euros                               |
| Importe vencido                           | 2.840.550,09 Euros                                 |
| Nominal pendiente de vencimiento          | 184.261.176,93 Euros                               |
| Nominal vencido y amortizado (pagado)     | 2.840.550,09 Euros                                 |
| Intereses devengados en el periodo        | 131.906,72 Euros                                   |
| Intereses devengados y no pagados         | 0,00 Euros   |

**III. INFORMACION INCLUIDA**

|   |
|---|
| * Liquidación del Período:22/05/20-24/08/20                         |
| * Flujos de Caja del Período:22/05/20-24/08/20                      |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Agosto de 2020 |

**MADRID RESIDENCIAL I**

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/20 - 24/08/20

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES        | Euros                |                      |
|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                      | Ingresos             | Pagos                |
| Amortización Bonos Titulización Hip. |                      | 2.627.026,33         |
| Amortización Participaciones Hip.    | 5.417.956,34         |                      |
| Amortización Ptmos. Subordinados     |                      | 2.840.550,09         |
| Ingresos por inmuebles               | 290.927,57           |                      |
| <b>II. INTERESES</b>                 |                      |                      |
| Intereses pagados a los BTH          |                      | 54.206,84            |
| Intereses recibidos de las CTHs      | 411.923,72           |                      |
| Intereses Préstamo B                 |                      | 131.906,72           |
| Intereses Ptmos. Subordinados        |                      | 999.794,74           |
| Intereses Inversiones Temporales     | -8.369,04            |                      |
| <b>III. GASTOS</b>                   |                      |                      |
| Comisiones y gastos:                 |                      | 119.685,93           |
| Neto SWAP                            | 113.974,42           |                      |
| Margen de Intermediación Financiera  |                      | 0,00                 |
| <b>Total Ingresos/Pagos</b>          | <b>6.226.413,01</b>  | <b>6.773.170,65</b>  |
| Saldo inicial 22/05/20               | 36.013.992,66        |                      |
| A Inversiones Temporales             |                      | 35.467.235,02        |
| <b>Total</b>                         | <b>42.240.405,67</b> | <b>42.240.405,67</b> |
| Retenciones practicadas el 24/08/20  | 10.299,30            |                      |
| A Inversiones Temporales             |                      | 10.299,30            |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 3142/20

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL I fluj.trim\Ago20